

eRed Folder : [Previous Doc](#) [Next Doc](#) [Go to Doc#](#)
[First Hit](#)

100: Entry 1 of 1

File: JPAB

Apr 27, 2001

FUB-NO: JF02001117974A

DOCUMENT-IDENTIFIER: JF 2001117974 A

TITLE: METHOD AND SYSTEM FOR INFERRING COMPLICATED SECURITIES USING LITTLE DIFFERENT
DECISION-THEORETIC STREAM AND PORTFOLIO CONSTITUTING METHOD

PUBN-DATE: April 27, 2001

INVENTOR-INFORMATION:

NAME

COUNTRY

JOSEPH, F TORAGU

SOPACHIMIRO, PASOKOTU

IRWIN, T FANDERUHOOFU

ANARATIROGO, PAPAGEORGOYU

ASSIGNEE-INFORMATION:

NAME

COUNTRY

TRUSTEES OF COLUMBIA UNIV IN THE CITY OF NEW YORK

APPL-NO: JP11286401

APPL-DATE: October 7, 1999

INT-CL (IPC): G06F 17/60

ABSTRACT:

PROBLEM TO BE SOLVED: To provide a method and a system for inferring complicated securities and a portfolio constituting method.

SOLUTION: The method for inferring complicated securities is provided with a step for providing at least one multi-variation function to be integrated expressing an inferred value at least in one part of the complicated securities in the case of integration within the range of integration, a step for calculating an integrated value at a point inside the range of integration provided from a little different decision-theoretic stream with a computer and a step for performing one of purchasing, owning and selling of the complicated securities on the basis of an entire value including the estimated value, and the portfolio constituting method is provided with a step for calculating a lot of latent loss function values at the point provided from the little different decision-theoretic stream inside the area of stochastic market elements with the computer, a step for determining the cumulative distribution function of the said function value, a step for determining a dangerous value as one of function values corresponding to the designated level of credit, and a step for constituting the portfolio corresponding to the comparison of the dangerous value and the designated target value.

COPYRIGHT: (C) 2001, JPO

[Previous Doc](#) [Next Doc](#) [Go to Doc#](#)

(19) 日本国特許庁 (J P)

(12) 公開特許公報 (A)

(11) 特許出願公開番号

特開2001-117974

(P2001-117974A)

(43) 公開日 平成13年4月27日 (2001.4.27)

(51) Int. Cl.⁷
G 0 6 F 17/00

識別記号

P I
G 0 6 F 15/21

特 記 号 (参 考)

Q 5 B 0 4 9
Z

審査請求 有 請求項の数38 O L (全 10 頁)

(21) 出願番号 特願平11-286401

(74) 代理人 100038258

弁護士 杉村 純秀 (外 2 名)

(22) 出願日 平成11年10月7日 (1999.10.7)

最終頁に続く

(54) 【発明の名称】 少相連決定論的列を使用する複雑な証券の推定方法およびシステムと、ポートフォリオ構成

(57) 【要約】

【課題】 複雑な証券の推定方法およびシステムと、ポートフォリオ構成方法とを提供する。

【解決手段】 複雑な証券の推定方法は、積分の範囲で積分した場合、前記複雑な証券の少なくとも一部の推定値を表す少なくとも1つの多変量積分関数を得るステップと、少相連決定論的列から得られた前記積分の範囲内の点における積分値をコンピュータによって計算するステップと、前記推定値を含む全体値に基づいて前記複雑な証券を、購入、保有および売却のうち1つを行うステップとを具え、ポートフォリオ構成方法は、確率的市場要素の領域における、少相連決定論的列から得られた点における多数の潜在的損失関数値を、コンピュータによって計算するステップと、前記関数値の累積分布関数を決定するステップと、危険値を、指定された信用のレベルに対応する前記関数値の1つとして決定するステップと、前記ポートフォリオを、前記危険値と指定された目標値との比較に応じて構成するステップとを具える。

